

Resultado Mensal dos Investimentos - Por Artigo

Esta tabela demonstra o resultado final dos Investimentos do Hortoprev para o mês em questão, esclarecendo o valor em R\$ da marcação a mercado mensal dos ativos, variação monetária no mês, rentabilidade no mês, proporcionalidade do total do ativo no total do patrimônio do Instituto e proporcionalidade das cotas do Instituto nos Fundos.

Mês/Ano	dezembro-15					
Artigo de Enquadramento / Ativo Financeiro	Valor Total	Variação Mês (R\$)	Rent. Mes (%)	% P.L. Hortoprev	% P.L. Fundo	
Art. 7o, Inciso I, Alínea A - TP SELIC	R\$ 58.967.598,61	R\$ 988.501,64		20,31%		
TITULOS (NTN-B)	R\$ 32.735.459,90	R\$ 530.207,65	1,646%	11,28%	0,00%	
TITULOS (NTN-C)	R\$ 26.232.138,71	R\$ 458.293,99	1,778%	9,04%	0,00%	
Art. 7o, Inciso I, Alínea B - FI TP	R\$ 38.703.920,66	R\$ 566.529,77		13,33%		
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 8.023.875,47	R\$ 116.795,35	1,477%	2,76%	0,19%	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	R\$ 15.476.195,54	R\$ 156.991,03	1,154%	5,33%	0,20%	
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 15.203.849,65	R\$ 292.743,39	1,963%	5,24%	0,63%	
Art. 7o, Inciso III - RF Ref.	R\$ 55.044.921,13	R\$ 935.848,27		18,96%		
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	R\$ 11.190.877,82	R\$ 227.140,76	2,072%	3,86%	0,94%	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 4.142.318,81	R\$ 61.172,20	1,499%	1,43%	0,46%	
BRA1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 2.637.589,37	R\$ 39.280,30	1,512%	0,91%	4,11%	
BRADERCO INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IMA-B 5	R\$ 2.343.862,12	R\$ 48.779,71	2,125%	0,81%	1,77%	
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	R\$ 25.219.646,54	R\$ 301.132,34	1,208%	8,69%	1,07%	
FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B	R\$ 1.057.523,56	R\$ 22.887,74	2,212%	0,36%	1,93%	
LEME IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO EM RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	R\$ 4.862.671,43	R\$ 49.263,75	1,023%	1,68%	4,79%	
LMX IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 966.935,45	-R\$ 33.064,55	-1,075%	0,33%	2,23%	
TOWER BRIDGE RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5	R\$ 2.623.496,03	R\$ 219.256,02	-7,713%	0,90%	0,46%	
Art. 7o, Inciso IV - RF	R\$ 39.218.177,13	R\$ 459.432,54		13,51%		
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 8.637.314,73	R\$ 100.781,25	1,181%	2,98%	0,15%	
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	R\$ 25.462.596,98	R\$ 291.084,95	1,156%	8,77%	0,61%	
INFINITY LOTUS FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 2.562.409,08	R\$ 35.344,38	1,399%	0,88%	6,10%	
QUEST YIELD FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 2.555.856,34	R\$ 32.221,96	1,277%	0,88%	2,00%	
Art. 7o, Inciso VI - FIDC (Aberto)	R\$ 10.334.685,47	-R\$ 38.812,29		3,56%		
LEME MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	R\$ 9.377.028,04	-R\$ 51.443,56	-0,546%	3,23%	2,53%	
OURINVEST FIDC FINANCEIROS - SUPPLIERCARD	R\$ 957.657,43	R\$ 12.631,27	1,337%	0,33%	0,26%	
Art. 7o, Inciso VII, Alínea A - FIDC (Fechado)	R\$ 2.821.500,43	R\$ 23.879,48		0,97%		
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR2	R\$ 58.070,28	-R\$ 2.050,67	-3,411%	0,02%	0,64%	
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR3	R\$ 61.396,33	-R\$ 2.168,12	-3,411%	0,02%	0,68%	
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR4	R\$ 30.878,60	-R\$ 1.090,44	-3,411%	0,01%	0,34%	
FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS - FIDC PREMIUM	R\$ 2.671.155,22	R\$ 29.188,71	1,870%	0,92%	2,17%	
Art. 7o, Inciso VII, Alínea B - Credito Privado	R\$ 11.082.895,24	R\$ 109.133,19		3,82%		
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA XIII RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	R\$ 7.271.188,00	R\$ 106.140,00	1,481%	2,50%	7,24%	
LEME BRASPREV FI RENDA FIXA LONGO PRAZO PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	R\$ 3.811.707,24	R\$ 2.993,19	0,079%	1,31%	12,78%	
Art. 8o, Inciso I - FIA Ref.	R\$ 7.537.212,43	-R\$ 164.235,84		2,60%		

BTG PACTUAL MULTIGESTORES IBOVESPA INSTITUCIONAL FI EM QUOTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	R\$	2.707.928,30	-R\$	38.535,23	-1,403%	0,93%	30,25%
DAYCOVAL DIVIDENDOS IBOVESPA FUNDO DE INVESTIMENTOS DE AÇÕES	R\$	1.370.678,25	-R\$	49.902,28	-3,513%	0,47%	17,70%
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$	3.458.605,88	-R\$	75.798,33	-2,145%	1,19%	0,82%
Art. 8o, Inciso III - FIA	R\$	30.928.556,07	-R\$	414.893,21			10,65%
BB AÇÕES CONSUMO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$	1.954.428,88	-R\$	19.568,80	-0,991%	0,67%	2,68%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	R\$	2.046.820,32	R\$	2.336,44	0,114%	0,71%	0,66%
GERAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$	3.487.952,73	-R\$	41.976,29	-1,189%	1,20%	2,56%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$	1.998.721,36	-R\$	64.064,74	-3,106%	0,69%	0,75%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$	3.705.524,53	-R\$	11.823,72	-0,318%	1,28%	5,01%
QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$	7.703.367,08	R\$	49.170,77	-0,634%	2,65%	25,22%
QUEST AÇÕES FIC FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	R\$	5.544.568,52	-R\$	218.509,77	-3,792%	1,91%	4,61%
WESTERN ASSET DIVIDEND YIELD FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$	1.908.330,99	-R\$	42.095,05	-2,158%	0,66%	5,31%
AZ QUEST SMALL CAPS FIC FI DE AÇÕES	R\$	1.617.934,67	-R\$	69.513,77	-4,119%	0,56%	1,73%
BRZ EQUITY FUNDAMENTAL INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$	960.906,99	R\$	1.151,72	0,182%	0,33%	2,06%
Art. 8o, Inciso IV - FIM	R\$	11.255.011,90	R\$	170.086,29			3,88%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA VI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	R\$	4.007.048,45	R\$	60.573,60	1,535%	1,38%	4,52%
FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO SCULPTOR CRÉDITO PRIVADO	R\$	1.990.946,52	R\$	33.925,59	1,734%	0,69%	3,31%
LEME FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	R\$	5.257.016,93	R\$	75.587,10	1,459%	1,81%	14,16%
Art. 8o, Inciso V - FIP	R\$	11.770.109,64	-R\$	33.802,94			4,05%
ÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES - ÁTICO FLORESTAL	R\$	2.031.797,58	-R\$	3.720,76	-0,183%	0,70%	1,17%
ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA - FIP	R\$	9.417.132,20	-R\$	30.862,95	-0,327%	3,24%	2,74%
FIP BRASIL ÓLEO & GÁS FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES	R\$	321.179,86	R\$	780,77	0,244%	0,11%	0,40%
Art. 8o, Inciso VI - FII	R\$	10.538.536,11	-R\$	224.260,49			3,63%
AQUILLA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	R\$	2.562.566,63	-R\$	7.965,34	-0,310%	0,88%	1,44%
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND	R\$	303.338,70	-R\$	21.748,20	-5,711%	0,10%	0,01%
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO AGENCIAS CAIXA - FII	R\$	1.960.000,00	-R\$	62.040,00	-3,068%	0,68%	0,45%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	R\$	5.712.630,78	-R\$	132.506,95	-2,267%	1,97%	19,11%
Em enquadramento - TP CETIP	R\$	1.322.649,97	-R\$	224.368,46			0,46%
TITULOS (TDA)	R\$	1.322.649,97	-R\$	224.368,46	-3,461%	0,46%	0,00%
Disponibilidades Financeiras	R\$	97.940,49	R\$	-			0,03%
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS (CONTAS CORRENTES HORTOPREV)	R\$	97.940,49	R\$	-	0,000%	0,03%	0,00%
Art. 9o - Imóveis	R\$	661.500,00	R\$	-			0,23%
IMÓVEIS (TERRENOS)	R\$	661.500,00	R\$	-	0,000%	0,23%	0,00%
Total Geral	R\$	290.285.215,28	R\$	2.153.037,95			100,00%

Resultado Mensal dos Investimentos - Por Instituição Financeira

Esta tabela demonstra o resultado final dos investimentos do Hortoprev para o mês em questão, esclarecendo o valor em R\$ da marcação a mercado mensal dos ativos, variação monetária no mês, rentabilidade no mês, proporcionalidade do total do ativo no total do patrimônio do Instituto e proporcionalidade das cotas do Instituto nos Fundos.

Mês/Ano	dezembro-15					
Instituição Financeira / Ativo Financeiro	Valor Total	Variação do Mês (R\$)	Rent. Mes (%)	% P.L. Hortoprev	% P.L. Fundo	
AQUILLA ASSET	R\$ 2.562.566,63	-R\$ 7.965,34			0,88%	
AQUILLA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	R\$ 2.562.566,63	-R\$ 7.965,34	-0,310%	0,88%	1,439%	
ÁTICO ADMINISTRAÇÃO DE RECURSOS LTDA	R\$ 11.448.929,78	-R\$ 34.583,71			3,94%	
ÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES - ÁTICO FLORESTAL	R\$ 2.031.797,58	-R\$ 3.720,76	-0,183%	0,70%	1,166%	
ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA - FIP	R\$ 9.417.132,20	-R\$ 30.862,95	-0,327%	3,24%	2,738%	
BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	R\$ 38.234.133,43	R\$ 416.171,03			13,17%	
BB AÇÕES CONSUMO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 1.954.428,88	-R\$ 19.568,80	-0,991%	0,67%	2,678%	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 4.142.318,81	R\$ 61.172,20	1,499%	1,43%	0,459%	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 8.023.875,47	R\$ 116.795,35	1,477%	2,76%	0,194%	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	R\$ 15.476.195,54	R\$ 156.991,03	1,154%	5,33%	0,201%	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 8.637.314,73	R\$ 100.781,25	1,181%	2,98%	0,146%	
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.	R\$ 11.190.877,82	R\$ 227.140,76			3,86%	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	R\$ 11.190.877,82	R\$ 227.140,76	2,072%	3,86%	0,938%	
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS	R\$ 2.343.862,12	R\$ 48.779,71			0,81%	
BRADESCO INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IMA-B 5	R\$ 2.343.862,12	R\$ 48.779,71	2,125%	0,81%	1,772%	
BRASIL PLURAL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R\$ 150.345,21	-R\$ 5.309,23			0,05%	
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR2	R\$ 58.070,28	-R\$ 2.050,67	-3,411%	0,02%	0,639%	
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR3	R\$ 61.396,33	-R\$ 2.168,12	-3,411%	0,02%	0,675%	
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR4	R\$ 30.878,60	-R\$ 1.090,44	-3,411%	0,01%	0,340%	
BRIDGE ADMINISTRADORA DE RECURSOS LTDA	R\$ 2.623.496,03	R\$ 219.256,02			0,90%	
TOWER BRIDGE RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5	R\$ 2.623.496,03	R\$ 219.256,02	-7,713%	0,90%	0,459%	
BRZ INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 960.906,99	R\$ 1.151,72			0,33%	
BRZ EQUITY FUNDAMENTAL INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 960.906,99	R\$ 1.151,72	0,182%	0,33%	2,060%	
BTG PACTUAL WM GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R\$ 3.011.267,00	-R\$ 60.283,43			1,04%	
BTG PACTUAL MULTIGESTORES IBOVESPA INSTITUCIONAL FI EM QUOTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	R\$ 2.707.928,30	-R\$ 38.535,23	-1,403%	0,93%	30,248%	
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND	R\$ 303.338,70	-R\$ 21.748,20	-5,711%	0,10%	0,010%	
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	R\$ 137.454.578,20	R\$ 1.815.807,46			47,35%	
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 15.203.849,65	R\$ 292.743,39	1,963%	5,24%	0,626%	
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA VI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	R\$ 4.007.048,45	R\$ 60.573,60	1,535%	1,38%	4,525%	
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA XIII RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	R\$ 7.271.188,00	R\$ 106.140,00	1,481%	2,50%	7,237%	
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	R\$ 25.462.596,98	R\$ 291.084,95	1,156%	8,77%	0,613%	
























FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	R\$ 25.219.646,54	R\$ 301.132,34	1,208%	8,69%	1,068%
TITULOS (NTN-B)	R\$ 32.735.459,90	R\$ 530.207,65	1,646%	11,28%	0,000%
TITULOS (NTN-C)	R\$ 26.232.138,71	R\$ 458.293,99	1,778%	9,04%	0,000%
TITULOS (TDA)	R\$ 1.322.649,97	-R\$ 224.368,46	-3,461%	0,46%	0,000%
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT ADMINISTRACAO DE RECURSOS LTDA	R\$ 1.370.678,25	-R\$ 49.902,28		0,47%	
DAYCOVAL DIVIDENDOS IBOVESPA FUNDO DE INVESTIMENTOS DE AÇÕES	R\$ 1.370.678,25	-R\$ 49.902,28	-3,513%	0,47%	17,703%
FMD GESTÃO DE RECURSOS LTDA.	R\$ 1.990.946,52	R\$ 33.925,59		0,69%	
FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO SCULPTOR CRÉDITO PRIVADO	R\$ 1.990.946,52	R\$ 33.925,59	1,734%	0,69%	3,313%
G F GESTÃO DE RECURSOS S/A	R\$ 9.192.198,62	-R\$ 117.864,75		3,17%	
GERAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$ 3.487.952,73	-R\$ 41.976,29	-1,189%	1,20%	2,559%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$ 1.998.721,36	-R\$ 64.064,74	-3,106%	0,69%	0,752%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$ 3.705.524,53	-R\$ 11.823,72	-0,318%	1,28%	5,009%
GENUS CAPITAL GROUP GESTAO DE RECURSOS LTDA	R\$ 1.057.523,56	R\$ 22.887,74		0,36%	
FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B	R\$ 1.057.523,56	R\$ 22.887,74	2,212%	0,36%	1,927%
INFINITY ASSET MANAGEMENT ADMINISTRAÇÃO DE RECURSOS LTDA	R\$ 2.562.409,08	R\$ 35.344,38		0,88%	
INFINITY LOTUS FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 2.562.409,08	R\$ 35.344,38	1,399%	0,88%	6,097%
INTERATIVA INVESTIMENTOS LTDA.	R\$ 2.637.589,37	R\$ 39.280,30		0,91%	
BRA1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 2.637.589,37	R\$ 39.280,30	1,512%	0,91%	4,113%
ITAU DTVM S.A.	R\$ 3.458.605,88	-R\$ 75.798,33		1,19%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 3.458.605,88	-R\$ 75.798,33	-2,145%	1,19%	0,819%
LEME INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 23.308.423,64	R\$ 76.400,48		8,03%	
LEME BRASPREV FI RENDA FIXA LONGO PRAZO PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	R\$ 3.811.707,24	R\$ 2.993,19	0,079%	1,31%	12,782%
LEME FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	R\$ 5.257.016,93	R\$ 75.587,10	1,459%	1,81%	14,158%
LEME IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO EM RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	R\$ 4.862.671,43	R\$ 49.263,75	1,023%	1,68%	4,793%
LEME MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITORIOS	R\$ 9.377.028,04	-R\$ 51.443,56	-0,546%	3,23%	2,526%
LMX GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R\$ 966.935,45	-R\$ 33.064,55		0,33%	
LMX IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 966.935,45	-R\$ 33.064,55	-1,075%	0,33%	2,229%
OLIVEIRA TRUST DTVM S.A.	R\$ 957.657,43	R\$ 12.631,27		0,33%	
OURINVEST FIDC FINANCEIROS - SUPPLIERCARD	R\$ 957.657,43	R\$ 12.631,27	1,337%	0,33%	0,260%
PETRA PERSONAL TRADER CTVM S/A	R\$ 2.671.155,22	R\$ 29.188,71		0,92%	
FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS - FIDC PREMIUM	R\$ 2.671.155,22	R\$ 29.188,71	1,870%	0,92%	2,169%
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA	R\$ 7.703.367,08	R\$ 49.170,77		2,65%	
QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$ 7.703.367,08	R\$ 49.170,77	-0,634%	2,65%	25,225%

QUEST INVESTIMENTOS LTDA.	R\$ 9.718.359,53	-R\$ 255.801,58			3,35%	
QUEST AÇÕES FIC FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	R\$ 5.544.568,52	-R\$ 218.509,77	-3,792%	1,91%	4,605%	
QUEST YIELD FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO	R\$ 2.555.856,34	R\$ 32.221,96	1,277%	0,88%	1,998%	
AZ QUEST SMALL CAPS FIC FI DE AÇÕES	R\$ 1.617.934,67	-R\$ 69.513,77	-4,119%	0,56%	1,734%	
RIO BRAVO INVESTIMENTOS DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIARIOS LTDA	R\$ 1.960.000,00	-R\$ 62.040,00			0,68%	
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO AGENCIAS CAIXA - FII	R\$ 1.960.000,00	-R\$ 62.040,00	-3,068%	0,68%	0,453%	
VALORA GESTÃO DE INVESTIMENTOS LTDA.	R\$ 321.179,86	R\$ 780,77			0,11%	
FIP BRASIL ÓLEO & GÁS FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES	R\$ 321.179,86	R\$ 780,77	0,244%	0,11%	0,400%	
VECTOR ADMINISTRAÇÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA / QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA	R\$ 5.712.630,78	-R\$ 132.506,95			1,97%	
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	R\$ 5.712.630,78	-R\$ 132.506,95	-2,267%	1,97%	19,111%	
VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA	R\$ 2.046.820,32	R\$ 2.336,44			0,71%	
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	R\$ 2.046.820,32	R\$ 2.336,44	0,114%	0,71%	0,665%	
WESTERN ASSET MANAGEMENT COMPANY DTVM LTDA	R\$ 1.908.330,99	-R\$ 42.095,05			0,66%	
WESTERN ASSET DIVIDEND YIELD FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	R\$ 1.908.330,99	-R\$ 42.095,05	-2,158%	0,66%	5,309%	
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	R\$ 97.940,49	R\$ -			0,03%	
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS (CONTAS CORRENTES HORTOPREV)	R\$ 97.940,49	R\$ -	0,000%	0,03%	0,000%	
HORTOPREV	R\$ 661.500,00	R\$ -			0,23%	
IMÓVEIS (TERRENOS)	R\$ 661.500,00	R\$ -	0,000%	0,23%	0,000%	
Total Geral	R\$ 290.285.215,28	R\$ 2.153.037,95			100,00%	

Resultado Mensal dos Investimentos - Desempenho Total

Esta tabela demonstra a rentabilidade total da carteira esclarecendo a rentabilidade proporcional por Fundo dentro da carteira, ou seja, o quando cada Fundo contribuiu para o resultado final da Carteira no mês.

Resultado da Carteira:		0,67%		
Mês/Ano		dezembro-15		
Fundo / Ativo	Rentabilidade no Mês	% Total do Patrimônio	Contribuição para Resultado Mensal	
DI				
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	1,18%	2,98%	0,04%	
BRA1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	1,51%	0,91%	0,01%	
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	1,16%	8,77%	0,10%	
INFINITY LOTUS FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	1,40%	0,88%	0,01%	
QUEST YIELD FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO	1,28%	0,88%	0,01%	
IBOVESPA				
BTG PACTUAL MULTIGESTORES IBOVESPA INSTITUCIONAL FI EM QUOTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	-1,40%	0,93%	-0,01%	
DAYCOVAL DIVIDENDOS IBOVESPA FUNDO DE INVESTIMENTOS DE AÇÕES	-3,51%	0,47%	-0,02%	
GERAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	-1,19%	1,20%	-0,01%	
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	-3,11%	0,69%	-0,02%	
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	-0,32%	1,28%	0,00%	
ITAU FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	-2,14%	1,19%	-0,03%	
QUEST AÇÕES FIC FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	-3,79%	1,91%	-0,07%	
BRZ EQUITY FUNDAMENTAL INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	0,18%	0,33%	0,00%	
IBrX				
QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	-0,63%	2,65%	-0,02%	
IDIV				
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	0,11%	0,71%	0,00%	
WESTERN ASSET DIVIDEND YIELD FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	-2,16%	0,66%	-0,01%	
IDKA 2A				
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	1,96%	5,24%	0,10%	
IGPM				
TITULOS (NTN-C)	1,78%	9,04%	0,16%	
IMA-B				
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	1,50%	1,43%	0,02%	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	1,48%	2,76%	0,04%	
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	1,21%	8,69%	0,10%	
FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B	2,21%	0,36%	0,01%	
LEME IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO EM RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,02%	1,68%	0,02%	
LMX IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	-1,08%	0,33%	0,00%	
IMA-B 5				
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	2,07%	3,86%	0,08%	
BRASESCO INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IMA-B 5	2,13%	0,81%	0,02%	
TOWER BRIDGE RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5	-7,71%	0,90%	-0,07%	
IMOBILIARIO				
AQUILLA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	-0,31%	0,88%	0,00%	
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND	-5,71%	0,10%	-0,01%	

FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO AGENCIAS CAIXA - FII	-3,07%	0,68%		-0,02%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	-2,27%	1,97%		-0,04%
IPCA				
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA VI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1,53%	1,38%		0,02%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA XIII RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,48%	2,50%		0,04%
FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO SCULPTOR CRÉDITO PRIVADO	1,73%	0,69%		0,01%
LEME MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS	-0,55%	3,23%		-0,02%
TÍTULOS (NTN-B)	1,65%	11,28%		0,19%
IRF-M 1				
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	1,15%	5,33%		0,06%
N/A				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS (CONTAS CORRENTES HORTOPREV)	0,00%	0,03%		0,00%
IMÓVEIS (TERRENOS)	0,00%	0,23%		0,00%
OUTROS				
ÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES - ÁTICO FLORESTAL	-0,18%	0,70%		0,00%
ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA - FIP	-0,33%	3,24%		-0,01%
BB AÇÕES CONSUMO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	-0,99%	0,67%		-0,01%
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR2	-3,41%	0,02%		0,00%
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR3	-3,41%	0,02%		0,00%
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR4	-3,41%	0,01%		0,00%
FIP BRASIL ÓLEO & GÁS FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES	0,24%	0,11%		0,00%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS - FIDC PREMIUM	1,87%	0,92%		0,02%
LEME BRASPREV FI RENDA FIXA LONGO PRAZO PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,08%	1,31%		0,00%
LEME FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1,46%	1,81%		0,03%
OURINVEST FIDC FINANCEIROS - SUPPLIERCARD	1,34%	0,33%		0,00%
SMLL				
AZ QUEST SMALL CAPS FIC FI DE AÇÕES	-4,12%	0,56%		-0,02%
TRM				
TÍTULOS (TDA)	-3,46%	0,46%		-0,02%

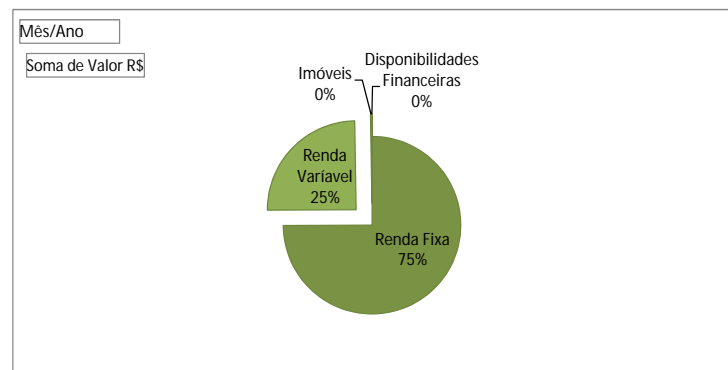
Enquadramento

Estes valores mostram se o Hortoprev está enquadrado ou não nos parâmetros da Resolução CMN 3922/2010.

Mês/Ano	dezembro-15	
Rótulos de Linha	Teto 25%	Teto 20%
AQUILLA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	1,44%	1,12%
ÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES - ÁTICO FLORESTAL	1,17%	0,89%
ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA - FIP	2,74%	4,11%
AZ QUEST SMALL CAPS FIC FI DE AÇÕES	1,73%	0,71%
BB AÇÕES CONSUMO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2,68%	0,85%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	0,94%	4,88%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	0,46%	1,81%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	0,19%	3,50%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,20%	6,75%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	0,15%	3,77%
BRA1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	4,11%	1,15%
BRDESCO INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IMA-B 5	1,77%	1,02%
BRZ EQUITY FUNDAMENTAL INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	2,06%	0,42%
BTG PACTUAL MULTIGESTORES IBOVESPA INSTITUCIONAL FI EM QUOTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	30,25%	1,18%
DAYCOVAL DIVIDENDOS IBOVESPA FUNDO DE INVESTIMENTOS DE AÇÕES	17,70%	0,60%
FIDC TRENBANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR2	0,64%	0,03%
FIDC TRENBANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR3	0,68%	0,03%
FIDC TRENBANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR4	0,34%	0,01%
FIP BRASIL ÓLEO & GÁS FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES	0,40%	0,14%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	0,63%	6,63%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA VI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	4,52%	1,75%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA XIII RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	7,24%	3,17%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	0,61%	11,11%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	1,07%	11,00%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	0,66%	0,89%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS - FIDC PREMIUM	2,17%	1,17%
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND	0,01%	0,13%
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO AGENCIAS CAIXA - FII	0,45%	0,86%
FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO SCULPTOR CRÉDITO PRIVADO	3,31%	0,87%
FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B	1,93%	0,46%
GERAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	2,56%	1,52%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	0,75%	0,87%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	5,01%	1,62%
INFINITY LOTUS FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	6,10%	1,12%
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	0,82%	1,51%
LEME BRASPREV FI RENDA FIXA LONGO PRAZO PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	12,78%	1,66%
LEME FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	14,16%	2,29%
LEME IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO EM RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4,79%	2,12%
LEME MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS	2,53%	4,09%
LMX IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	2,23%	0,42%
OURINVEST FIDC FINANCEIROS - SUPPLIERCARD	0,26%	0,42%
QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	25,22%	3,36%
QUEST AÇÕES FIC FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	4,61%	2,42%
QUEST YIELD FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO	2,00%	1,11%
TOWER BRIDGE RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5	0,46%	1,14%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	19,11%	2,49%
WESTERN ASSET DIVIDEND YIELD FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	5,31%	0,83%

Situação **Desenquadrado** Enquadrado

Mês/Ano	dezembro-15			
Rótulos de Linha	Soma de Valor R\$	%	Resultado	
Renda Fixa	R\$ 217.496.348,64	74,93%	Enquadrado	
Renda Variável	R\$ 72.029.426,15	24,81%	Enquadrado	
Imóveis	R\$ 661.500,00	0,23%	N/A	
Disponibilidades Financeiras	R\$ 97.940,49	0,03%	N/A	
Total Geral	R\$ 290.285.215,28	100,00%		



Mês/Ano	dezembro-15			
Artigos Resolução CMN 3922/2010	% Total	Limite	Situação	
Art. 7o, Inciso I, Alínea A - TP SELIC	20,31%	100,00%	Enquadrado	
Art. 7o, Inciso I, Alínea B - FI TP	13,33%	100,00%	Enquadrado	
Art. 7o, Inciso III - RF Ref.	18,96%	80,00%	Enquadrado	
Art. 7o, Inciso IV - RF	13,51%	30,00%	Enquadrado	
Art. 7o, Inciso VI - FIDC (Aberto)	3,56%	8,00%	Enquadrado	
Art. 7o, Inciso VII, Alínea A - FIDC (Fechado)	0,97%	2,00%	Enquadrado	
Art. 7o, Inciso VII, Alínea B - Crédito Privado	3,82%	5,00%	Enquadrado	
Art. 8o, Inciso I - FIA Ref.	2,60%	30,00%	Enquadrado	
Art. 8o, Inciso III - FIA	10,65%	15,00%	Enquadrado	
Art. 8o, Inciso IV - FIM	3,88%	5,00%	Enquadrado	
Art. 8o, Inciso V - FIP	4,05%	5,00%	Enquadrado	
Art. 8o, Inciso VI - FII	3,63%	5,00%	Enquadrado	
Em enquadramento - TP CETIP	0,46%	0,00%	Em enquadramento	
Disponibilidades Financeiras	0,03%	N/A	N/A	
Art. 9o - Imóveis	0,23%	N/A	N/A	

Limite 15% PL (Soma Art. 7º VI e VII) Art. 7º § 5º **Enquadrado**

Retorno e Risco dos Fundos Individualmente

Esta tabela demonstra o retorno acumulado dos Fundos em alguns períodos, bem como sua volatilidade e índice de sharpe (relação entre volatilidade e retorno, quanto maior, melhor) e Value-at-Risk (quantidade, em porcentagem, que o Fundo pode perder em um mês em um cenário ruim, considerando seus dados segundo uma distribuição normal, quanto maior, pior).

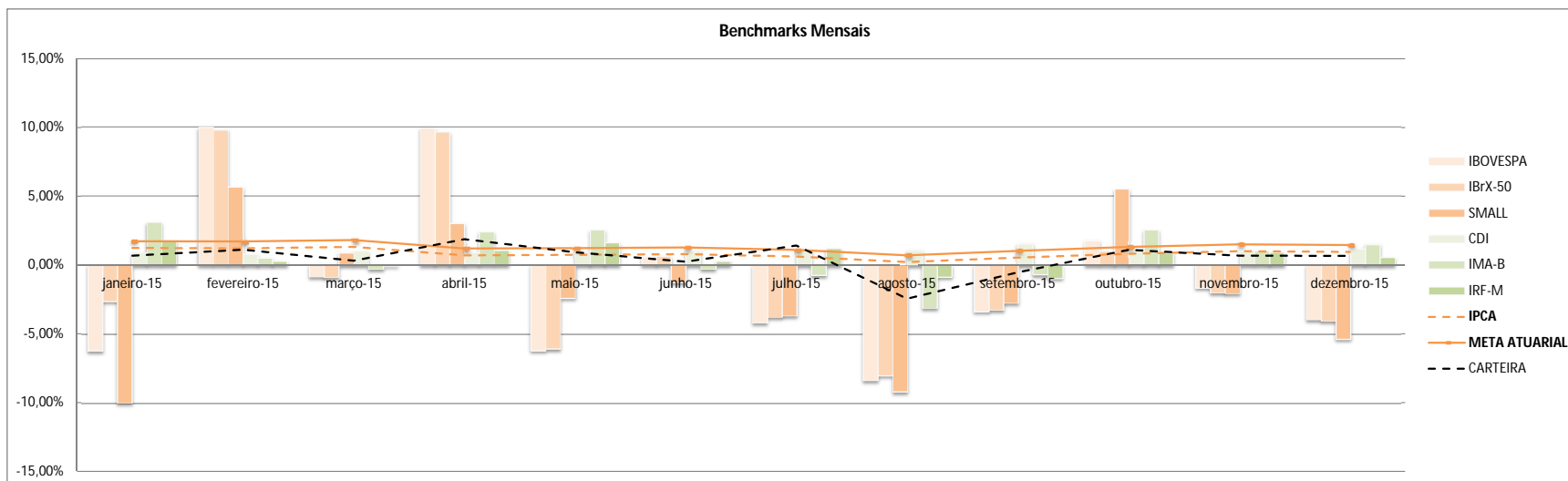
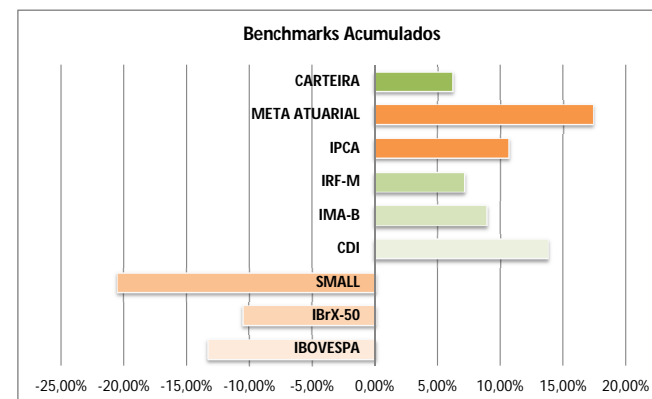
Nome do Fundo	Retorno 24 Meses	Retorno 12 Meses ²	Retorno Ano	Retorno Mês	Retorno Esperado	Risco (Volatilidade)	Sharpe	VaR ¹
AQUILLA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	7,93%	9,51%	9,51%	-0,31%	0,34%	2,36%	-7,68	4,23%
ÁTICO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES - ÁTICO FLORESTAL	2,49%	-4,94%	-4,94%	-0,18%	0,12%	2,02%	-11,67	3,44%
ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA - FIP	36,24%	37,34%	37,34%	-0,33%	1,55%	8,06%	1,26	14,81%
BB AÇÕES CONSUMO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	0,83%	-14,21%	-14,21%	-0,99%	0,12%	4,30%	-5,86	7,20%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 LONGO PRAZO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	24,42%	13,64%	13,64%	2,07%	0,92%	1,16%	-1,42	2,82%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO	24,34%	6,56%	6,56%	1,50%	0,94%	2,29%	-0,75	4,71%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO	29,23%	11,02%	11,02%	1,48%	1,10%	2,28%	1,39	4,86%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	24,08%	13,57%	13,57%	1,15%	0,90%	0,19%	-10,62	1,21%
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	25,97%	14,61%	14,61%	1,18%	0,97%	0,13%	-0,70	1,18%
BRA1 FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	25,53%	12,85%	12,85%	1,51%	0,95%	0,48%	-1,10	1,75%
BRADESCO INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA IMA-B 5	18,21%	14,43%	14,43%	2,13%	0,99%	0,88%	-8,97	2,43%
BRZ EQUITY FUNDAMENTAL INSTITUCIONAL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	-4,73%	-10,46%	-10,46%	0,18%	-0,13%	3,78%	-8,14	6,09%
BTG PACTUAL MULTIGESTORES IBOVESPA INSTITUCIONAL FI EM QUOTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	-7,11%	-10,80%	-10,80%	-1,40%	-0,21%	4,56%	-7,27	7,30%
DAYCOVAL DIVIDENDOS IBOVESPA FUNDO DE INVESTIMENTOS DE AÇÕES	-36,05%	-29,16%	-29,16%	-3,51%	-1,75%	4,47%	-13,89	5,60%
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR2	-87,68%	-11,15%	-11,15%	-3,41%	52,51%	320,54%	-0,35	579,75%
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR3	-99,26%	-11,81%	-11,81%	-3,41%	-12,21%	26,85%	-4,67	31,96%
FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL SR4	-99,79%	-11,81%	-11,81%	-3,41%	-16,21%	27,56%	-4,57	29,13%
FIP BRASIL ÓLEO & GÁS FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES	-4,84%	-48,66%	-48,66%	0,24%	2,43%	28,58%	-1,08	49,44%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO	28,76%	15,55%	15,55%	1,96%	1,06%	0,88%	3,08	2,51%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA VI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	30,21%	18,03%	18,03%	1,53%	1,11%	0,43%	9,66	1,81%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IPCA XIII RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	39,49%	17,46%	17,46%	1,48%	1,41%	1,52%	8,82	3,91%
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO	25,64%	14,40%	14,40%	1,16%	0,96%	0,13%	-3,35	1,16%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO CAIXA NOVO BRASIL IMA-B RENDA FIXA LP	24,28%	6,72%	6,72%	1,21%	0,93%	2,16%	-0,83	4,48%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	5,98%	-0,20%	-0,20%	0,11%	0,31%	3,66%	-5,49	6,32%
FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS - FIDC PREMIUM	15,84%	7,27%	7,27%	1,87%	0,62%	1,25%	-8,19	2,67%
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO - FII BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND	-8,28%	-1,61%	-1,61%	-5,71%	-0,32%	2,96%	-11,62	4,54%
FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO AGENCIAS CAIXA - FII	22,51%	4,09%	4,09%	-3,07%	0,87%	1,99%	-1,79	4,14%
FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO SCULPTOR CRÉDITO PRIVADO	25,72%	14,13%	14,13%	1,73%	0,96%	0,48%	-0,71	1,74%
FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B	5,57%	1,68%	1,68%	2,21%	0,24%	1,85%	-11,07	3,29%
GERAÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	2,67%	-6,46%	-6,46%	-1,19%	0,24%	5,14%	-4,55	8,69%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	10,33%	-6,83%	-6,83%	-3,11%	0,53%	5,00%	-3,15	8,75%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	4,37%	-6,39%	-6,39%	-0,32%	0,29%	4,67%	-4,65	7,96%
INFINITY LOTUS FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	27,78%	15,32%	15,32%	1,40%	1,03%	0,74%	2,32	2,25%
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO	-11,51%	-15,37%	-15,37%	-2,14%	-0,39%	4,92%	-7,64	7,69%
LEME BRASPREV FI RENDA FIXA LONGO PRAZO PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	2,53%	-7,11%	-7,11%	0,08%	0,14%	2,79%	-8,43	4,74%
LEME FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-13,31%	-23,00%	-23,00%	1,46%	-0,41%	6,24%	-6,31	9,86%
LEME IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO EM RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9,86%	-4,28%	-4,28%	1,02%	0,41%	2,14%	-7,56	3,94%
LEME MULTISSETORIAL IPCA - FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS	30,62%	16,12%	16,12%	-0,55%	1,12%	0,51%	8,96	1,96%
LMX IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	24,02%	12,60%	12,60%	-1,08%	0,91%	1,58%	-1,29	3,52%
OURINVEST FIDC FINANCIEROS - SUPPLIERCARD	29,79%	16,61%	16,61%	1,34%	1,09%	0,15%	25,60	1,33%
QUELUZ VALOR FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	-99,45%	-99,49%	-99,49%	-99,43%	-4,24%	20,64%	-6,08	29,71%
QUEST AÇÕES FIC FUNDO DE INVESTIMENTO DE AÇÕES	-11,13%	-17,06%	-17,06%	-3,79%	-0,38%	4,76%	-7,81	7,45%
AZ QUEST SMALL CAPS FIC FI DE AÇÕES	-9,87%	-11,79%	-11,79%	-4,12%	-0,33%	4,57%	-7,86	7,19%
QUEST YIELD FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO	23,03%	11,61%	11,61%	1,28%	0,87%	0,33%	-9,13	1,41%
TOWER BRIDGE RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5	13,08%	1,28%	1,28%	-7,71%	0,53%	1,98%	-6,56	3,79%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIARIO	10,33%	2,88%	2,88%	-2,27%	0,42%	1,61%	-9,78	3,07%
WESTERN ASSET DIVIDEND YIELD FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES	-14,27%	-18,16%	-18,16%	-2,16%	-0,55%	4,23%	-9,53	6,41%
META ATUARIAL (IPCA + 6%)	32,32%	18,80%	18,80%	1,45%	1,17%	0,33%	19,16	1,71%
CDI (ATIVO LIVRE DE RISCO)	26,06%	14,85%	14,85%	1,16%	0,97%	0,18%	0,00	1,26%

¹VaR Paramétrico Normal, horizonte de 21 dias, 95% de probabilidade.

Comportamento dos Índices

Estes dados demonstram o comportamento do mercado em seus principais indicadores (benchmarks) ao decorrer do ano e compara a Meta Atuarial e a Carteira de Investimentos do Hortoprev com estes.

MÊS	IBOVESPA	IBrX-50	SMALL	CDI	IMA-B	IRF-M	IPCA	META ATUARIAL	CARTEIRA
janeiro-15	-6,20%	-2,60%	-9,96%	0,93%	3,12%	1,79%	1,24%	1,73%	0,68%
fevereiro-15	9,97%	9,81%	5,68%	0,82%	0,54%	0,29%	1,22%	1,71%	1,12%
março-15	-0,84%	-0,88%	0,92%	1,04%	-0,28%	-0,03%	1,32%	1,81%	0,32%
abril-15	9,93%	9,66%	3,04%	0,95%	2,44%	1,09%	0,71%	1,20%	1,88%
maio-15	-6,17%	-6,05%	-2,37%	0,98%	2,57%	1,63%	0,74%	1,23%	0,93%
junho-15	0,61%	0,64%	-1,24%	1,06%	-0,27%	0,32%	0,79%	1,28%	0,24%
julho-15	-4,17%	-3,75%	-3,66%	1,18%	-0,73%	1,23%	0,62%	1,11%	1,42%
agosto-15	-8,33%	-7,98%	-9,16%	1,11%	-3,11%	-0,85%	0,22%	0,71%	-2,45%
setembro-15	-3,36%	-3,24%	-2,73%	1,57%	-0,68%	-0,94%	0,54%	1,03%	-0,53%
outubro-15	1,80%	1,05%	5,54%	1,11%	2,58%	0,92%	0,82%	1,31%	1,10%
novembro-15	-1,63%	-1,98%	-2,03%	1,06%	1,03%	0,92%	1,01%	1,50%	0,67%
dezembro-15	-3,93%	-4,04%	-5,34%	1,16%	1,52%	0,57%	0,96%	1,45%	0,67%
Acumulado	-13,31%	-10,47%	-20,52%	13,76%	8,89%	7,13%	10,67%	17,31%	6,15%
Média	-1,03%	-0,78%	-1,78%	1,08%	0,73%	0,58%	0,85%	1,34%	0,50%
Volatilidade	5,90%	5,53%	5,04%	0,19%	1,84%	0,87%	0,32%	0,32%	1,11%



Evolução do Patrimônio, Aplicações e Resgates

Estes dados demonstram a evolução do patrimônio do Instituto e e quais foram as movimentações de aplicações ou resgates no período.

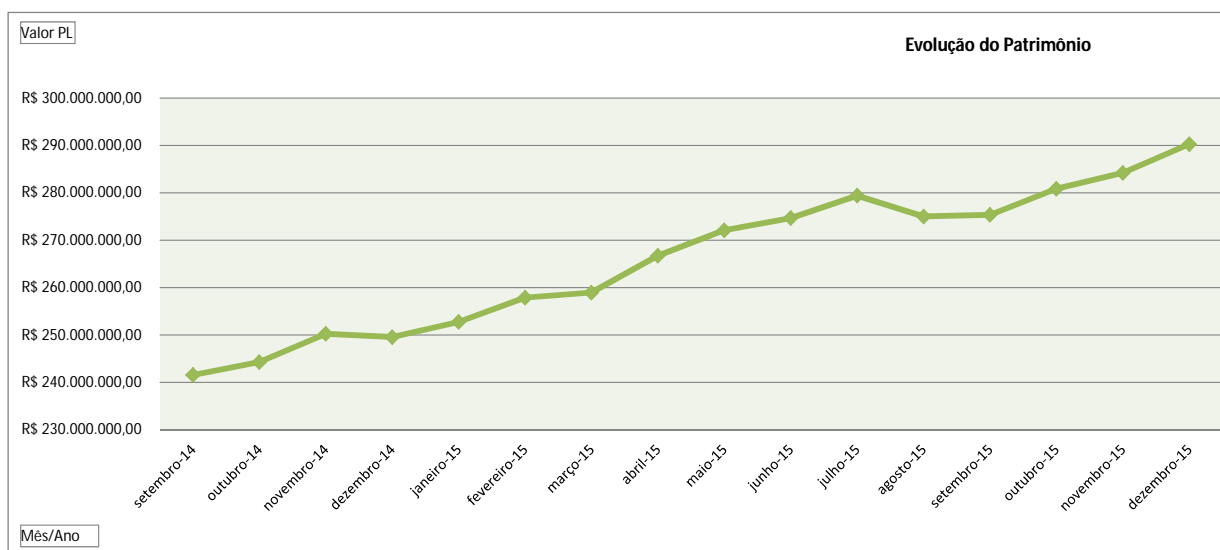
Patrimônio

Meses	Valor PL
setembro-14	R\$ 241.554.531,70
outubro-14	R\$ 244.287.758,15
novembro-14	R\$ 250.246.295,65
dezembro-14	R\$ 249.557.263,70
janeiro-15	R\$ 252.753.975,93
fevereiro-15	R\$ 257.885.905,48
março-15	R\$ 258.949.052,86
abril-15	R\$ 266.721.381,41
maio-15	R\$ 272.105.635,73
junho-15	R\$ 274.677.926,25
julho-15	R\$ 279.420.082,65
agosto-15	R\$ 275.011.564,06
setembro-15	R\$ 275.348.227,23
outubro-15	R\$ 280.874.005,62
novembro-15	R\$ 284.221.743,98
dezembro-15	R\$ 290.285.215,28

Aplicações e Resgates

Ano	2.015
Mês	12

Tabela Resumida de Aplicações e Resgates		
Fundo	Aplicação	Resgate
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	R\$ 5.670.000,00	R\$ 1.992.906,93
LEME BRASPREV FI RENDA FIXA LONGO PRAZO PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO		R\$ 459.514,35
Total Geral	R\$ 5.670.000,00	R\$ 2.452.421,28



Credenciamento

Abaixo se encontra a lista de instituições financeiras que foram credenciadas pelo Hortoprev, bem como data e validade de seu credenciamento.

Instituição Financeira	CNPJ	Situação	Data do Credenciamento	Validade Credenciamento	Processo	Situação Processo
J. SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA	621800470001-31	CRENCIADO	31/07/2015	27/01/2016	25/2015	Concluído
JS ADMINISTRAÇÃO DE RECURSOS S.A.	438268330001-19	CRENCIADO	31/07/2015	27/01/2016	26/2015	Concluído
ITAÚ UNIBANCO S.A.	607011900001-04	CRENCIADO	14/08/2015	10/02/2016	33/2015	Concluído
EQUITAS ADMINISTRAÇÃO DE FUNDOS DE INVESTIMENTOS LTDA	082048170001-93	CRENCIADO	03/09/2015	01/03/2016	78/2015	Concluído
WESTERN ASSET MANAGEMENT COMPANY DTVM LTDA	074372410001-41	CRENCIADO	09/09/2015	07/03/2016	90/2015	Concluído
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA	072508640001-00	CRENCIADO	15/09/2015	13/03/2016	106/2015	Concluído
FMD GESTÃO DE RECURSOS LTDA.	104461310001-50	CRENCIADO	25/09/2015	23/03/2016	121/2015	Concluído
INFINITY ASSET MANAGEMENT ADMINISTRAÇÃO DE RECURSOS LTDA	034031810001-95	CRENCIADO	01/10/2015	29/03/2016	136/2015	Concluído
BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A.	308229360001-69	CRENCIADO	06/10/2015	03/04/2016	125/2015	Concluído
BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMENT S.A. DTVM	623751340001-44	CRENCIADO	14/10/2015	11/04/2016	49/2015	Concluído
BRZ INVESTIMENTOS LTDA	028881520001-06	CRENCIADO	16/10/2015	13/04/2016	137/2015	Concluído
TERCON INVESTIMENTOS LTDA	091214540001-95	CRENCIADO	21/10/2015	18/04/2016	175/2015	Concluído
J. MALUCELLI DTVM LTDA.	766214570001-85	CRENCIADO	22/10/2015	19/04/2016	174/2015	Concluído
RIO BRAVO INVESTIMENTOS DTVM LTDA	726000260001-81	CRENCIADO	26/10/2015	23/04/2016	190/2015	Concluído
RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	038646070001-08	CRENCIADO	26/10/2015	23/04/2016	191/2015	Concluído
FOCO DTVM LTDA.	003295980001-67	CRENCIADO	03/11/2015	01/05/2016	198/2015	Concluído
GENUS CAPITAL GROUP GESTAO DE RECURSOS LTDA	101723640001-02	CRENCIADO	09/11/2015	07/05/2016	152/2015	Concluído
AQUILLA ASSET MANAGEMENT	089645450001-20	CRENCIADO	10/11/2015	08/05/2016	197/2015	Concluído
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	003603050001-04	CRENCIADO	30/11/2015	28/05/2016	238/2015	Concluído
LEME INVESTIMENTOS LTDA	741989120001-56	CRENCIADO	07/12/2015	04/06/2016	256/2015	Concluído
BRIDGE ADMINISTRADORA DE RECURSOS LTDA	110107790001-42	CRENCIADO	23/12/2015	20/06/2016	277/2015	Concluído
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA	045063940001-05	CRENCIADO	23/12/2015	20/06/2016	278/2015	Concluído
GF GESTÃO DE RECURSOS S.A.	096301880001-26	CRENCIADO	14/01/2016	12/07/2016	280/2015	Concluído